

## DAFTAR PUSTAKA

- [1] E. Tandelilin, “Dasar-dasar Manajemen Investasi,” in *Manajemen Investasi*, vol. 1, Yogyakarta, 2010, hal. 1–34.
- [2] Bursa Efek Indonesia (BEI)/Indonesia Stock Exchange (IDX), “Saham.” <https://www.idx.co.id/id/produk/saham> (diakses Apr 22, 2024).
- [3] S. T. Enow, “The Merits of Buy and Hold Strategy in International Financial Markets,” *J. Econ. Soc. Dev.*, vol. 10, no. November, hal. 133–137, 2023.
- [4] K. Ahmad, *Dasar-dasar Manajemen Investasi*, 1 ed. Jakarta: PT Rineka Cipta, 1996.
- [5] R. Desiyanti, *Teori Investasi dan Portofolio*, 2 ed. Padang: Bung Hatta University Press, 2017.
- [6] S. Wahyuni, 2021, Analisis Investasi Portofolio Optimal dengan Menggunakan Model Markowitz dan Model Indeks Tunggal pada Sektor Finance di Indeks Papan Utama yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia, *Skripsi*, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Muhammadiyah Pontianak, Pontianak.
- [7] M. R. Habibi, *Hukum Pasar Modal Indonesia*, 1 ed. Malang: Inara Publisher, 2022.
- [8] A. Misbahussurur, 2009, Estimasi Parameter Distribusi Gamma Dengan Metode Maksimum Likelihood, *Skripsi*, Fakultas Sains dan Teknologi, Universitas Islam Negeri (UIN) Maulana Malik Ibrahim Malang, Malang.
- [9] R. E. Walpole, R. H. Myers, S. L. Myers, dan K. Ye, *Probability & Statistics for Engineers & Scientists*, 9 ed. Boston: Pearson Education, Inc, 2011.
- [10] Jogiyanto, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, 3 ed. Yogyakarta: BPFE, 2003.
- [11] R. E. Situmorang, D. A. I. Maruddani, dan R. Santoso, “Pembentukan Portofolio Saham dengan Metode Markowitz dan Pengukuran Value At Risk Berdasarkan Generalized Extreme Value (Studi Kasus: Saham Perusahaan the IDX Top Ten Blue 2017),” *J. Gaussian*, vol. 7, no. 2, hal.

212–223, 2018, doi: 10.14710/j.gauss.v7i2.26655.

- [12] B. N. Oktaviani dan A. Wijayanto, “Aplikasi Single Index Model dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index,” vol. 4, no. 1, hal. 189–202, 2016, [Daring]. Tersedia pada: <http://journal.unnes.ac.id/sju/index.php/maj>.
- [13] S. Hasbiah, Anwar, dan B. Bado, “Model Markowitz dalam Keputusan Investasi Saham Pada Index LQ45 di Bursa Efek Indonesia,” *J. Ekon. dan Pendidik.*, vol. 5, hal. 69–78, 2022, doi: 10.26858/jekpend.
- [14] University of Jember, “Koset dan Teorema Lagrange,” *College Sidekick*, 2024. <https://www.collegesidekick.com/study-docs/12951053> (diakses Jun 07, 2024).
- [15] Muniri, *Struktur Aljabar*, 1 ed. Yogyakarta: Kalimedia, 2016.
- [16] S. S. Rao, *Engineering Optimization Theory and Practice*, 4 ed. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2009.
- [17] F. R. Lifa, Helmi, dan E. Sulistianingsih, “Portofolio Model Markowitz Dengan Pendekatan Two-Fund Theorem,” *Bul. Ilm. Math. Stat. dan Ter.*, vol. 02, no. 1, hal. 27–32, 2013, [Daring]. Tersedia pada: <https://jurnal.untan.ac.id/index.php/jbmstr/article/viewFile/1537/1481>.
- [18] D. G. Luenberger, *Investment Science*. New York: Oxford University Press Inc., 1998.
- [19] C. Hsieh, “On Asymptotic Log-Optimal Portfolio Optimization,” *Automatica*, vol. 151, no. 110901, hal. 1–11, 2023, doi: 10.1016/j.automatica.2023.110901.
- [20] C. H. Hsieh, J. A. Gubner, dan B. R. Barmish, “Rebalancing Frequency Considerations for Kelly-Optimal Stock Portfolios in a Control-Theoretic Framework,” *Proc. IEEE Conf. Decis. Control*, vol. Dec. 17–18, hal. 5820–5825, 2018, doi: 10.1109/CDC.2018.8619189.
- [21] I. Ghozali, *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 25*, 9 ed. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro, 2018.